

嘉实多元收益债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由代董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.11 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	55
§ 11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实多元收益债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实多元债券	
基金主代码	070015	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 9 月 10 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,703,345,212.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
下属分级基金的交易代码	070015	070016
报告期末下属分级基金的份额总额	1,359,977,077.60 份	343,368,134.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金通过谋求较高的当期收益，力争资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>在本基金的债券(可转债除外)投资过程中，本基金管理人将采取积极主动的投资策略，在宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究的基础上，以中长期利率趋势分析和债券市场供求关系研究为核心，结合信用息差水平分析和收益率曲线形态分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。本基金所采取的主动投资策略涉及债券组合构建的三个步骤：确定债券组合久期、确定债券组合期限结构及类属配置、单个资产选择。其中，每个步骤都采取特定的主动投资子策略，以尽可能地控制风险、提高基金投资收益。</p> <p>具体包括：1、资产配置策略；2、债券投资策略（债券投资（可转债除外）、可转债投资）；3、股票投资策略（新股申购、公开增发等一级市场投资、二级市场股票投资、存托凭证投资）；4、权证投资策略。</p>
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 姓名	胡勇钦	郭明

负责人	联系电话	(010) 65215588	(010) 66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010) 65215588	(010) 66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100020	100140
法定代表人		经雷	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
本期已实现收益	-20,286,079.64	-10,826,754.92
本期利润	14,437,835.58	676,192.03
加权平均基金份 额本期利润	0.0094	0.0012
本期加权平均净 值利润率	0.76%	0.10%
本期基金份额净 值增长率	0.77%	0.58%
3.1.2 期末数	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	50,216,415.93	10,194,519.20
期末可供分配基金份额利润	0.0369	0.0297
期末基金资产净值	1,653,083,517.54	415,101,738.78
期末基金份额净值	1.216	1.209
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	131.62%	120.33%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实多元债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.98%	0.23%	0.94%	0.04%	-1.92%	0.19%
过去三个月	-0.12%	0.24%	1.75%	0.09%	-1.87%	0.15%
过去六个月	0.77%	0.30%	3.83%	0.09%	-3.06%	0.21%
过去一年	-0.51%	0.28%	5.99%	0.08%	-6.50%	0.20%
过去三年	0.57%	0.35%	16.31%	0.08%	-15.74%	0.27%
自基金合同生效起至今	131.62%	0.34%	97.92%	0.12%	33.70%	0.22%

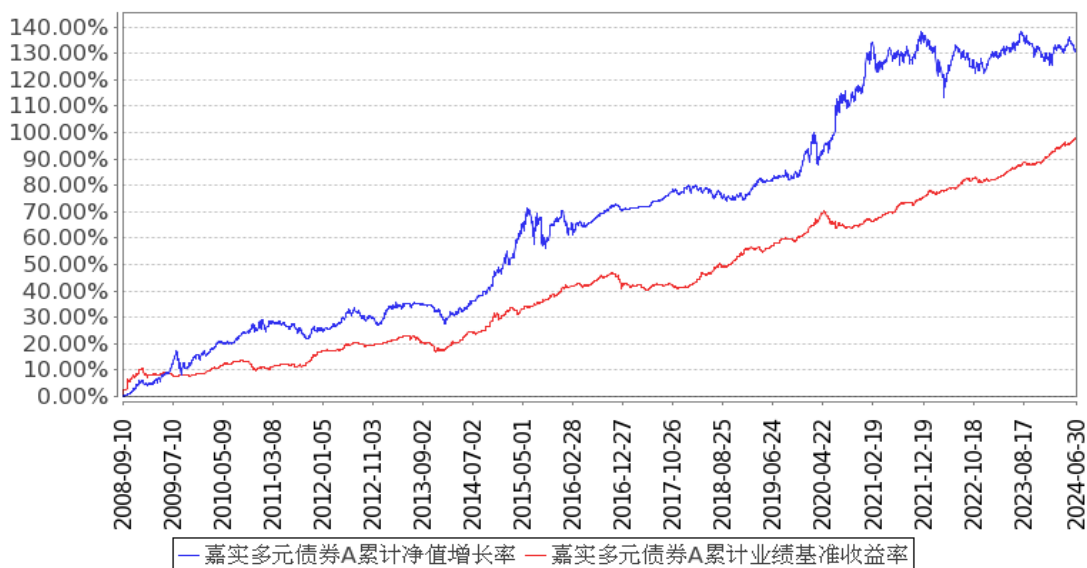
嘉实多元债券 B

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

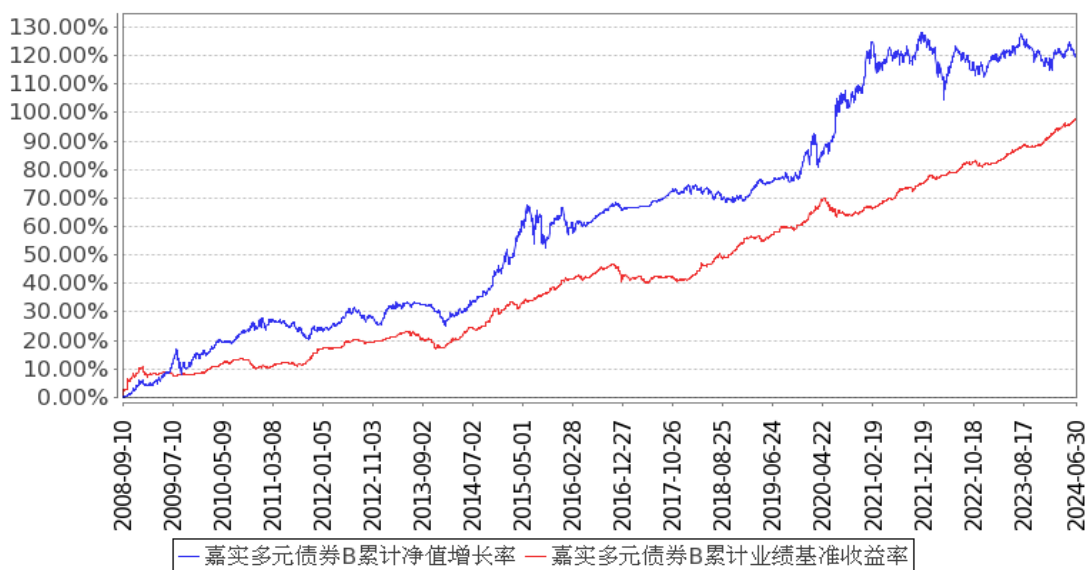
	率①	准差②		④		
过去一个月	-1.06%	0.27%	0.94%	0.04%	-2.00%	0.23%
过去三个月	-0.23%	0.25%	1.75%	0.09%	-1.98%	0.16%
过去六个月	0.58%	0.30%	3.83%	0.09%	-3.25%	0.21%
过去一年	-0.79%	0.28%	5.99%	0.08%	-6.78%	0.20%
过去三年	-0.40%	0.35%	16.31%	0.08%	-16.71%	0.27%
自基金合同生效起至今	120.33%	0.34%	97.92%	0.12%	22.41%	0.22%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实多元债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年09月10日至2024年06月30日)



嘉实多元债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年09月10日至2024年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2024年6月30日，基金管理人共管理351只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
洪流	本基金、嘉实策略	2019年8月1日	-	25年	曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、

	混合、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实阿尔法优选混合、嘉实品质优选股票、嘉实兴锐优选一年持有期混合、嘉实欣荣混合（LOF）基金经理				经纪业务管理部副总经理，兴业证券研发中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019年2月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。现任平衡风格投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
董福焱	本基金、嘉实策略混合、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实精选平衡混合基金经理	2022 年 5 月 21 日	-	14 年	曾任英国德勤会计师事务所审计师，博时基金管理有限公司行业研究员，天弘基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司投资经理。2018 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任职于上海 GARP 投资策略组，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
李宇昂	本基金、嘉实新思路混合、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实双季瑞享 6 个月持有债券基金经理	2022 年 5 月 21 日	-	8 年	曾任招商基金管理有限公司固定收益投资部研究员，宝盈基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、基金经理。2021 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司固收与配置组，任投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

24 年 H1 债券市场大幅走牛，利率大幅下行，10y 以下品种利率创近几年的新低。久期策略效果最优。其中，中债总财富指数上涨 3.83%，中债信用债总财富指数上涨 2.64%，10y 国债收益率最终下行至 2.21%。一季度降准，二季度存款利率降息、社融总量偏弱、机构欠配等因素成为了下行催化剂。信用债供给量较为有限，在供不应求的环境下收益率大幅下行，部分品种信用利差已经降至历史最低水平，超长期信用债发行有所放量，收益率同样大幅下行。

债券部分基于宏观和政策的判断，积极的对组合的久期和仓位进行的调整，以中短期险高等级债券位置为主，并一定仓位参与利率债的交易。组合年初维持相对中性态度，从二季度起开始大幅增加 5-7 年期和 10 年期及以上利率债品种并提高组合久期。转债方面，仓位进行灵活调整，考虑到市场情绪依然一般，转债溢价率水平中性偏高，估仓位维持中低配水平。品种上，还是选择公用事业、煤炭有色、半导体、化工、汽车零部件等相关的平衡型可转债。

股票部分，2024 年上半年 A 股市场先跌后反弹再跌。下跌的主要原因是减量的市场环境：上半年 6 个月 M1 同比增速逐级下行，同比增速分别为 5.9%、1.2%、1.1%、-1.4%、-4.2%、-5%，微

观层面 2 季度北上资金的流入流出数据和权益型基金 2 季度的申赎情况也对其有所印证。分析减量的原因，是抵押物资产价格的下行导致不再产生货币乘数效应，反而可能因追加担保而收缩流动性。买资产买的不是铜铁砖瓦，买的是资产的叙事，资产价格取决于资产背后的叙事，在抵押物资产价格下行引发去杠杆和风险资产流动性紧缩时，主流资金更关注保值能力而非增值空间，更交易现实（短久期）而非预期（长久期）。本产品股票部分对于一季度市场的下跌应对较好，并在其后的反弹中取得了相对和绝对收益。但是二季度 5 月中下旬之后股票部分的回撤比市场下跌的要大，主要的原因是 430 和 517 之后对经济基本面反转主观上形成了乐观的判断，以交易反转而非波动的心态应对，导致浮盈没有兑现，仓位维持在高位。也正是因为这一错误的主观判断，导致产品在房地产、非银金融、可选消费等内需相关的顺周期资产暴露较多，对受益于通缩的类债资产配置相对较少，在资金抛弃长久期资产涌向短久期避险资产、抛弃增值空间而拥抱保值确定性的跷跷板行情中，相对收益一般。操作上，由于我们是逆向投资的风格，抱着逆向投资的心态在左侧去抓主观意愿的拐点，却忽略了信心的修复比疾病的传播要复杂的多，更忽略了市场偏好经历过去几次波动教育后，早已降到更关注客观能不能的右侧机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实多元债券 A 基金份额净值为 1.216 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.77%；截至本报告期末嘉实多元债券 B 基金份额净值为 1.209 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.58%；业绩比较基准收益率为 3.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年预计经济仍保持稳中有进的态势，高质量发展推进，经济转型加快，行业之间分化加大。预计全年实现 5% 左右的经济目标。整体上，经济的方向和趋势不会有大的变化。政策方向，预计下半年财政有所加快，货币政策更加积极。海外可以期待美国货币政策是否边际调整。

资产层面，债券在较低的利率水平上，波动有所加大，但中长期下行的趋势和逻辑并没有发生变化。转债在溢价率压缩至低位后，泡沫已经消化，后续跟随正股波动。

股票部分，风险资产的流动性是最值得关注的因素。一方面，M1 同比增速的情况不会没有外部性；另一方面，从盘面上也能看到避险资产在缩圈——从资源、公用事业、出口链、央企，收缩到保值属性最强的央企和大行。这种缩圈类似 2021 年下半年赛道资产的缩圈——在白酒、医药、半导体、新能源中缩圈到当时业绩确定性最强的新能源。缩圈的本质是资金的流出。考虑到公募基金目前仓位水平与指数点位之间的背离，流动性问题尤其值得重视，谨防出清的价格出现。特别是对于预期较一致、基于宏大叙事的相对拥挤的标的。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实多元收益债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	3,552,817.77	44,530,280.09
结算备付金		17,651,674.40	24,299,630.42
存出保证金		226,388.99	288,680.36
交易性金融资产	6.4.7.2	2,568,411,008.55	3,168,830,885.87
其中：股票投资		410,480,238.01	509,131,148.58
基金投资		-	-
债券投资		2,157,930,770.54	2,659,699,737.29
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	40,011,506.84	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,479,853.14	-
应收股利		-	-
应收申购款		76,114.08	904,908.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,632,409,363.77	3,238,854,385.34
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		553,098,520.38	493,095,743.50
应付清算款		3,036,074.74	43,477,268.12
应付赎回款		5,769,397.12	1,086,292.28

应付管理人报酬		1,326,946.48	1,815,102.20
应付托管费		379,127.57	518,600.66
应付销售服务费		141,640.75	251,708.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		72,069.51	68,746.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	400,330.90	480,068.51
负债合计		564,224,107.45	540,793,530.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,703,345,212.10	2,171,236,027.34
未分配利润	6.4.7.12	364,840,044.22	526,824,827.47
净资产合计		2,068,185,256.32	2,698,060,854.81
负债和净资产总计		2,632,409,363.77	3,238,854,385.34

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，嘉实多元债券 A 基金份额净值 1.216 元，基金份额总额 1,359,977,077.60 份，嘉实多元债券 B 基金份额净值 1.209 元，基金份额总额 343,368,134.50 份，基金份额总额合计为 1,703,345,212.10 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实多元收益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		32,443,376.16	65,897,600.10
1. 利息收入		197,421.73	131,495.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	186,454.89	131,495.51
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,966.84	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,058,725.00	61,499,843.65
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,949,457.45	30,815,760.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-4,625,577.72	29,248,559.10
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,516,310.17	1,435,524.34
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	46,226,862.17	4,201,669.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	77,817.26	64,591.94
减：二、营业总支出		17,329,348.55	10,187,556.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,138,537.70	5,007,171.21
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,611,010.77	1,430,620.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,063,833.46	677,292.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,337,469.00	2,897,257.64
其中：卖出回购金融资产支出		4,337,469.00	2,897,257.64
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		38,980.36	41,123.65
8. 其他费用	6.4.7.23	139,517.26	134,090.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,114,027.61	55,710,044.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,114,027.61	55,710,044.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		15,114,027.61	55,710,044.00

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实多元收益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,171,236,027.34	-	526,824,827.47	2,698,060,854.81
二、本期期初净资产	2,171,236,027.34	-	526,824,827.47	2,698,060,854.81

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-467,890,815.24	-	-161,984,783.25	-629,875,598.49
(一)、综合收益总额	-	-	15,114,027.61	15,114,027.61
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-467,890,815.24	-	-101,164,685.95	-569,055,501.19
其中：1. 基金申购款	724,576,109.33	-	174,608,890.71	899,185,000.04
2. 基金赎回款	-1,192,466,924.57	-	-275,773,576.66	-1,468,240,501.23
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-75,934,124.91	-75,934,124.91
四、本期期末净资产	1,703,345,212.10	-	364,840,044.22	2,068,185,256.32
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,180,159,981.52	-	248,168,194.49	1,428,328,176.01
二、本期期初净资产	1,180,159,981.52	-	248,168,194.49	1,428,328,176.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	166,976,938.13	-	99,358,502.88	266,335,441.01
(一)、综合收益总额	-	-	55,710,044.00	55,710,044.00
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	166,976,938.13	-	43,648,458.88	210,625,397.01
其中：1. 基金申	564,851,434.07	-	140,975,811.82	705,827,245.89

购款				
2. 基金赎回款	-397,874,495.94	-	-97,327,352.94	-495,201,848.88
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,347,136,919.65	-	347,526,697.37	1,694,663,617.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实多元收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]865号《关于核准嘉实多元收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》于2008年9月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,579,775,847.06份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	3,552,817.77
等于: 本金	3,552,397.32
加: 应计利息	420.45
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	3,552,817.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	516,381,534.92	-	410,480,238.01	-105,901,296.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,137,675.06	452,266,382.99	-13,243,237.41
	银行间市场	1,662,556,236.41	22,366,187.55	20,741,963.59
	合计	2,124,928,181.75	25,503,862.61	2,157,930,770.54
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,641,309,716.67	25,503,862.61	2,568,411,008.55	-98,402,570.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	40,011,506.84	-
合计	40,011,506.84	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	300,367.45
其中：交易所市场	254,101.97
银行间市场	46,265.48
应付利息	-
预提费用	99,950.76
合计	400,330.90

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实多元债券 A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,482,412,078.35	1,482,412,078.35
本期申购	348,321,432.51	348,321,432.51
本期赎回 (以“-”号填列)	-470,756,433.26	-470,756,433.26
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,359,977,077.60	1,359,977,077.60

嘉实多元债券 B

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	688,823,948.99	688,823,948.99
本期申购	376,254,676.82	376,254,676.82
本期赎回 (以“-”号填列)	-721,710,491.31	-721,710,491.31
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	343,368,134.50	343,368,134.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实多元债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	131,631,747.99	233,267,451.57	364,899,199.56
本期期初	131,631,747.99	233,267,451.57	364,899,199.56
本期利润	-20,286,079.64	34,723,915.22	14,437,835.58
本期基金份额交易产生的变动数	-1,474,078.66	-25,101,342.78	-26,575,421.44
其中：基金申购款	29,358,467.90	57,205,107.75	86,563,575.65
基金赎回款	-30,832,546.56	-82,306,450.53	-113,138,997.09
本期已分配利润	-59,655,173.76	-	-59,655,173.76
本期末	50,216,415.93	242,890,024.01	293,106,439.94

嘉实多元债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,934,641.06	108,990,986.85	161,925,627.91
本期期初	52,934,641.06	108,990,986.85	161,925,627.91
本期利润	-10,826,754.92	11,502,946.95	676,192.03
本期基金份额交易产生的变动数	-15,634,415.79	-58,954,848.72	-74,589,264.51
其中：基金申购款	20,742,581.00	67,302,734.06	88,045,315.06
基金赎回款	-36,376,996.79	-126,257,582.78	-162,634,579.57
本期已分配利润	-16,278,951.15	-	-16,278,951.15
本期末	10,194,519.20	61,539,085.08	71,733,604.28

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	22,314.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	162,168.51
其他	1,972.30
合计	186,454.89

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,949,457.45
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-11,949,457.45

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	651,073,352.15
减：卖出股票成本总额	661,796,514.64
减：交易费用	1,226,294.96
买卖股票差价收入	-11,949,457.45

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	36,396,017.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-41,021,595.54
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-4,625,577.72

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,376,074,495.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,375,685,991.09
减：应计利息总额	41,309,004.73
减：交易费用	101,095.05
买卖债券差价收入	-41,021,595.54

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,516,310.17
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,516,310.17

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	46,226,862.17
股票投资	8,541,017.32
债券投资	37,685,844.85
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	46,226,862.17

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	77,081.35
基金转出费收入	735.91
合计	77,817.26

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	40,278.42
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	20,966.50
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	139,517.26

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,138,537.70	5,007,171.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,306,412.42	473,068.05
应支付基金管理人的净管理费	7,832,125.28	4,534,103.16

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.70% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,611,010.77	1,430,620.37

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	-	893,261.46	893,261.46
中国工商银行	-	31,267.62	31,267.62
嘉实财富	-	939.80	939.80
合计	-	925,468.88	925,468.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	-	551,404.66	551,404.66
中国工商银行	-	28,237.19	28,237.19
嘉实财富	-	944.00	944.00
合计	-	580,585.85	580,585.85

注：（1）本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：B 类基金份额日销售服务费=B 类基金份额前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	3,552,817.77	22,314.08	1,531,849.79	27,078.06

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

嘉实多元债券 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024年4月18日	-	2024年4月18日	0.395	50,980,681.48	8,674,492.28	59,655,173.76	-
合计	-	-	-	0.395	50,980,681.48	8,674,492.28	59,655,173.76	-
嘉实多元债券 B								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024年4月18日	-	2024年4月18日	0.331	13,415,407.87	2,863,543.28	16,278,951.15	-
合计	-	-	-	0.331	13,415,407.87	2,863,543.28	16,278,951.15	-

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 370,115,520.38 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1928022	19 兴业银行二级 01	2024 年 7 月 2 日	103.84	679,000	70,509,363.60
2228017	22 邮储银行二级 01	2024 年 7 月 2 日	104.81	900,000	94,331,046.58
1928022	19 兴业银行二级 01	2024 年 7 月 4 日	103.84	521,000	54,102,177.38
2028017	20 农业银行永续债 01	2024 年 7 月 4 日	101.73	218,000	22,177,438.63
2028038	20 中国银行二级 01	2024 年 7 月 4 日	105.88	400,000	42,350,885.25
2128019	21 中国银行永续债 01	2024 年 7 月 4 日	104.12	300,000	31,237,357.81
2128022	21 交通银行永续债	2024 年 7 月 4 日	103.95	300,000	31,184,061.37
2128025	21 建设银行二级 01	2024 年 7 月 4 日	105.89	577,000	61,097,584.10
合计				3,895,000	406,989,914.72

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 182,983,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过谋求较高的当期收益，力争资产的长期稳定增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	147,145,686.30	349,916,299.05
合计	147,145,686.30	349,916,299.05

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	797,965,254.42	1,250,996,731.15
AAA 以下	408,796,373.14	687,512,155.90
未评级	804,023,456.68	371,274,551.19
合计	2,010,785,084.24	2,309,783,438.24

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性

风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	3,552,817.77	-	-	-	3,552,817.77
结算备付金	17,651,674.40	-	-	-	17,651,674.40
存出保证金	226,388.99	-	-	-	226,388.99
交易性金融资产	470,687,627.38	854,476,970.10	832,766,173.06	410,480,238.01	2,568,411,008.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	40,011,506.84	-	-	-	40,011,506.84
应收清算款	-	-	-	2,479,853.14	2,479,853.14
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	76,114.08	76,114.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	532,130,015.38	854,476,970.10	832,766,173.06	413,036,205.23	2,632,409,363.77
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	553,098,520.38	-	-	-	553,098,520.38
应付清算款	-	-	-	3,036,074.74	3,036,074.74
应付赎回款	-	-	-	5,769,397.12	5,769,397.12
应付管理人报酬	-	-	-	1,326,946.48	1,326,946.48
应付托管费	-	-	-	379,127.57	379,127.57
应付销售服务费	-	-	-	141,640.75	141,640.75
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	72,069.51	72,069.51
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	400,330.90	400,330.90
负债总计	553,098,520.38	-	-	11,125,587.07	564,224,107.45
利率敏感度缺口	-20,968,505.00	854,476,970.10	832,766,173.06	401,910,618.16	2,068,185,256.32
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	44,530,280.09	-	-	-	44,530,280.09
结算备付金	24,299,630.42	-	-	-	24,299,630.42
存出保证金	288,680.36	-	-	-	288,680.36
交易性金融资产	512,971,062.17	1,047,986,800.77	1,098,741,874.35	509,131,148.58	3,168,830,885.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	904,908.60	904,908.60

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	582,089,653.04	1,047,986,800.77	1,098,741,874.35	510,036,057.18	3,238,854,385.34
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	493,095,743.50	-	-	-	493,095,743.50
应付清算款	-	-	-	43,477,268.12	43,477,268.12
应付赎回款	-	-	-	1,086,292.28	1,086,292.28
应付管理人报酬	-	-	-	1,815,102.20	1,815,102.20
应付托管费	-	-	-	518,600.66	518,600.66
应付销售服务费	-	-	-	251,708.87	251,708.87
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	68,746.39	68,746.39
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	480,068.51	480,068.51
负债总计	493,095,743.50	-	-	47,697,787.03	540,793,530.53
利率敏感度缺口	88,993,909.54	1,047,986,800.77	1,098,741,874.35	462,338,270.15	2,698,060,854.81

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-18,011,801.93	-12,498,618.51
市场利率下降25个基点	18,535,680.44	12,629,121.42	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	410,480,238.01	19.85	509,131,148.58	18.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	410,480,238.01	19.85	509,131,148.58	18.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	28,676,383.15	34,713,694.44
	业绩比较基准下降5%	-28,676,383.15	-34,713,694.44

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	676,909,630.47	1,096,966,787.41
第二层次	1,891,501,378.08	2,071,864,098.46
第三层次	-	-
合计	2,568,411,008.55	3,168,830,885.87

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	410,480,238.01	15.59
	其中：股票	410,480,238.01	15.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,157,930,770.54	81.98
	其中：债券	2,157,930,770.54	81.98
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	40,011,506.84	1.52
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,204,492.17	0.81
8	其他各项资产	2,782,356.21	0.11
9	合计	2,632,409,363.77	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,638,400.00	0.66
C	制造业	102,818,703.46	4.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,729,800.00	0.08
E	建筑业	34,279,228.70	1.66
F	批发和零售业	8,752,000.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	11,780,000.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,076,288.00	1.36
J	金融业	125,089,720.35	6.05
K	房地产业	59,320,097.50	2.87
L	租赁和商务服务业	24,996,000.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	410,480,238.01	19.85

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	3,500,045	63,805,820.35	3.09
2	601318	中国平安	1,000,000	41,360,000.00	2.00
3	601186	中国铁建	3,999,910	34,279,228.70	1.66
4	601888	中国中免	400,000	24,996,000.00	1.21
5	000100	TCL 科技	5,000,000	21,600,000.00	1.04
6	600050	中国联通	4,000,000	18,800,000.00	0.91
7	000932	华菱钢铁	4,000,000	17,720,000.00	0.86
8	600048	保利发展	2,000,000	17,520,000.00	0.85
9	601336	新华保险	527,400	15,837,822.00	0.77
10	600266	城建发展	4,222,400	15,791,776.00	0.76
11	000002	万科 A	2,000,000	13,860,000.00	0.67
12	600487	亨通光电	800,000	12,616,000.00	0.61
13	600376	首开股份	5,784,915	12,148,321.50	0.59

14	600583	海油工程	2,000,000	11,820,000.00	0.57
15	600029	南方航空	2,000,000	11,780,000.00	0.57
16	600166	福田汽车	5,000,000	11,250,000.00	0.54
17	300002	神州泰岳	1,142,400	9,276,288.00	0.45
18	000729	燕京啤酒	1,000,000	8,830,000.00	0.43
19	002462	嘉事堂	800,000	8,752,000.00	0.42
20	688488	艾迪药业	813,106	8,309,943.32	0.40
21	002252	上海莱士	1,000,000	7,820,000.00	0.38
22	601989	中国重工	1,424,600	7,023,278.00	0.34
23	002032	苏泊尔	81,600	4,088,160.00	0.20
24	601166	兴业银行	231,900	4,086,078.00	0.20
25	600188	兖矿能源	80,000	1,818,400.00	0.09
26	002608	江苏国信	223,200	1,729,800.00	0.08
27	600707	彩虹股份	245,700	1,673,217.00	0.08
28	601500	通用股份	230,421	1,230,448.14	0.06
29	002984	森麒麟	27,300	657,657.00	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	49,092,163.00	1.82
2	601333	广深铁路	36,348,867.78	1.35
3	601888	中国中免	34,408,364.80	1.28
4	000932	华菱钢铁	28,002,008.82	1.04
5	601818	光大银行	23,740,000.00	0.88
6	601728	中国电信	23,520,000.00	0.87
7	000100	TCL 科技	22,910,000.00	0.85
8	601919	中远海控	20,490,000.00	0.76
9	603551	奥普科技	20,315,698.00	0.75
10	000002	万 科 A	20,129,386.00	0.75
11	600048	保利发展	19,867,078.00	0.74
12	600050	中国联通	19,120,000.00	0.71
13	601336	新华保险	16,590,376.00	0.61
14	605555	德昌股份	14,011,528.16	0.52
15	002938	鹏鼎控股	13,770,058.00	0.51
16	600348	华阳股份	12,834,362.00	0.48
17	688488	艾迪药业	12,486,437.72	0.46
18	600895	张江高科	12,423,339.00	0.46
19	600583	海油工程	12,220,000.00	0.45
20	002668	TCL 智家	10,882,030.42	0.40

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000001	平安银行	54,340,000.00	2.01
2	601333	广深铁路	40,709,079.30	1.51
3	000651	格力电器	38,701,981.69	1.43
4	600023	浙能电力	36,677,000.29	1.36
5	601601	中国太保	36,655,908.90	1.36
6	603551	奥普科技	30,880,839.00	1.14
7	601818	光大银行	24,080,000.00	0.89
8	600028	中国石化	24,017,929.00	0.89
9	601728	中国电信	23,540,000.00	0.87
10	000002	万科 A	21,877,023.00	0.81
11	601919	中远海控	21,131,314.00	0.78
12	600482	中国动力	21,097,083.00	0.78
13	600027	华电国际	19,742,092.70	0.73
14	601800	中国交建	15,653,664.00	0.58
15	600348	华阳股份	14,849,378.50	0.55
16	605555	德昌股份	14,827,785.00	0.55
17	002938	鹏鼎控股	14,734,874.00	0.55
18	300750	宁德时代	14,588,842.60	0.54
19	601390	中国中铁	13,658,434.00	0.51
20	601600	中国铝业	13,203,146.00	0.49

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	554,604,586.75
卖出股票收入（成交）总额	651,073,352.15

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	253,127,950.10	12.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,014,906,430.10	49.07
	其中：政策性金融债	346,911,323.70	16.77
4	企业债券	20,382,208.22	0.99
5	企业短期融资券	20,193,802.74	0.98
6	中期票据	556,999,671.85	26.93
7	可转债（可交换债）	292,320,707.53	14.13

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,157,930,770.54	104.34

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019709	23 国债 16	1,250,000	126,951,883.56	6.14
2	1928022	19 兴业银行二级 01	1,200,000	124,611,540.98	6.03
3	2228017	22 邮储银行二级 01	900,000	94,331,046.58	4.56
4	2128025	21 建设银行二级 01	800,000	84,710,688.52	4.10
5	230208	23 国开 08	780,000	79,712,452.60	3.85

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，中信证券股份有限公司出现本期被监管部门立案调查，兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国建设银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	226,388.99
2	应收清算款	2,479,853.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	76,114.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,782,356.21

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132026	G 三峡 EB2	25,891,315.07	1.25
2	113044	大秦转债	11,184,653.92	0.54
3	113024	核建转债	11,129,626.40	0.54
4	110079	杭银转债	10,898,035.10	0.53
5	123169	正海转债	8,177,009.70	0.40
6	113064	东材转债	7,891,654.48	0.38
7	113050	南银转债	7,559,840.31	0.37
8	110058	永鼎转债	6,898,184.77	0.33
9	128109	楚江转债	6,656,905.78	0.32
10	113663	新化转债	6,551,827.57	0.32
11	110064	建工转债	5,642,784.87	0.27
12	127069	小熊转债	5,586,851.15	0.27
13	127054	双箭转债	5,212,943.67	0.25
14	123063	大禹转债	5,119,558.07	0.25
15	127044	蒙娜转债	5,040,555.24	0.24
16	123177	测绘转债	5,000,536.87	0.24
17	113060	浙 22 转债	4,878,991.89	0.24
18	127030	盛虹转债	4,827,626.75	0.23
19	123211	阳谷转债	4,792,610.42	0.23
20	123184	天阳转债	4,545,946.03	0.22
21	118013	道通转债	4,451,606.78	0.22
22	123194	百洋转债	3,968,009.84	0.19
23	127088	赫达转债	3,737,523.30	0.18
24	127037	银轮转债	3,670,178.08	0.18
25	128083	新北转债	3,651,760.52	0.18

26	113549	白电转债	3,617,885.08	0.17
27	123035	利德转债	3,528,305.91	0.17
28	113673	岱美转债	3,492,017.74	0.17
29	128076	金轮转债	3,456,172.60	0.17
30	127071	天箭转债	3,378,326.99	0.16
31	127083	山路转债	3,367,302.93	0.16
32	113675	新 23 转债	3,221,779.21	0.16
33	128128	齐翔转 2	3,204,029.75	0.15
34	128066	亚泰转债	3,063,568.22	0.15
35	111004	明新转债	2,931,819.22	0.14
36	113051	节能转债	2,679,849.35	0.13
37	123085	万顺转 2	2,644,923.82	0.13
38	123225	翔丰转债	2,642,782.55	0.13
39	110073	国投转债	2,603,164.09	0.13
40	127095	广泰转债	2,574,284.03	0.12
41	123214	东宝转债	2,564,446.68	0.12
42	118034	晶能转债	2,526,486.43	0.12
43	123071	天能转债	2,392,964.45	0.12
44	113664	大元转债	2,376,852.15	0.11
45	123025	精测转债	2,317,186.16	0.11
46	123082	北陆转债	2,265,715.14	0.11
47	127078	优彩转债	2,133,346.01	0.10
48	128122	兴森转债	2,120,710.41	0.10
49	113637	华翔转债	2,065,452.78	0.10
50	123090	三诺转债	2,033,039.92	0.10
51	123179	立高转债	1,985,472.40	0.10
52	123188	水羊转债	1,946,051.18	0.09
53	128137	洁美转债	1,932,045.22	0.09
54	123160	泰福转债	1,928,941.65	0.09
55	118014	高测转债	1,924,279.09	0.09
56	127049	希望转 2	1,889,957.03	0.09
57	127028	英特转债	1,880,507.52	0.09
58	128143	锋龙转债	1,865,008.53	0.09
59	113061	拓普转债	1,780,479.04	0.09
60	123171	共同转债	1,735,043.36	0.08
61	123091	长海转债	1,724,240.02	0.08
62	127064	杭氧转债	1,713,546.23	0.08
63	118036	力合转债	1,687,699.32	0.08
64	127050	麒麟转债	1,611,821.92	0.08
65	118012	微芯转债	1,499,838.30	0.07
66	123204	金丹转债	1,398,056.88	0.07
67	123152	润禾转债	1,335,800.76	0.06
68	123076	强力转债	1,311,557.26	0.06

69	123022	长信转债	1,265,564.05	0.06
70	127075	百川转 2	1,223,993.42	0.06
71	113534	鼎胜转债	1,163,374.52	0.06
72	110087	天业转债	1,127,151.00	0.05
73	128082	华锋转债	1,118,822.30	0.05
74	123157	科蓝转债	1,112,853.42	0.05
75	123130	设研转债	1,083,406.44	0.05
76	127042	嘉美转债	1,059,313.64	0.05
77	123199	山河转债	1,058,857.40	0.05
78	123100	朗科转债	930,905.38	0.05
79	113605	大参转债	868,530.21	0.04
80	113629	泉峰转债	678,339.32	0.03
81	123108	乐普转 2	661,698.55	0.03
82	113641	华友转债	563,141.93	0.03
83	127020	中金转债	498,656.19	0.02
84	128133	奇正转债	445,905.70	0.02
85	127073	天赐转债	79,625.04	0.00

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
嘉实多元 债券 A	9,572	142,078.68	992,805,548.86	73.00	367,171,528.74	27.00
嘉实多元 债券 B	8,915	38,515.78	263,999,546.91	76.89	79,368,587.59	23.11
合计	18,031	94,467.60	1,256,805,095.77	73.78	446,540,116.33	26.22

注：(1) 嘉实多元债券 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实多元债券 A 份额占嘉实多元债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实多元债券 A 份额占嘉实多元债券 A 总份额比例；

(2) 嘉实多元债券 B: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例, 分别为机构投资者持有嘉实多元债券 B 份额占嘉实多元债券 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实多元债券 B 份额占嘉实多元债券 B 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实多元债券 A	962,340.36	0.07
	嘉实多元债券 B	95,105.67	0.03
	合计	1,057,446.03	0.06

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	嘉实多元债券 A	50~100
	嘉实多元债券 B	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实多元债券 A	50~100
	嘉实多元债券 B	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
基金合同生效日 (2008年9月10日) 基金份额总额	998,363,495.91	3,581,412,351.15
本报告期期初基金份额总额	1,482,412,078.35	688,823,948.99
本报告期基金总申购份额	348,321,432.51	376,254,676.82
减: 本报告期基金总赎回份额	470,756,433.26	721,710,491.31
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,359,977,077.60	343,368,134.50

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券股份有限	3	195,814,591.07	16.24	126,988.95	15.38	-

公司						
中信证券 股份有限 公司	5	162,610,270. 99	13.49	113,827.19	13.78	-
招商证券 股份有限 公司	2	155,625,316. 77	12.91	108,940.14	13.19	-
国泰君安 证券股份 有限公司	3	154,567,914. 83	12.82	108,196.82	13.10	-
民生证券 股份有限 公司	1	108,451,317. 10	9.00	75,915.92	9.19	-
中信建投 证券股份 有限公司	3	83,806,159.4 4	6.95	58,664.31	7.10	-
开源证券 股份有限 公司	3	67,968,878.8 9	5.64	43,895.36	5.32	-
浙商证券 股份有限 公司	2	49,494,082.0 0	4.11	31,969.09	3.87	-
中国国际 金融股份 有限公司	2	47,106,687.0 0	3.91	32,974.63	3.99	-
海通证券 股份有限 公司	3	46,799,005.0 9	3.88	32,759.39	3.97	-
国信证券 股份有限 公司	2	46,066,900.6 0	3.82	34,543.66	4.18	-
天风证券 股份有限 公司	4	45,995,830.0 0	3.81	29,709.59	3.60	-
广发证券 股份有限 公司	5	18,557,774.0 0	1.54	11,987.80	1.45	-
长江证券 股份有限 公司	2	11,730,942.9 2	0.97	8,211.79	0.99	-
国盛证券 有限责任 公司	4	7,148,288.20	0.59	4,616.54	0.56	-
华源证券	2	3,933,980.00	0.33	2,540.27	0.31	-

股份有限 公司						
财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华 证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 报告期内，本基金退租以下交易单元：中国中金财富证券有限公司退租交易单元 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：天风证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额

		的比例 (%)				的比例 (%)
华泰证 券股份 有限公 司	86,908,412. 19	5.39	1,489,691,00 0.00	7.30	-	-
中信证 券股份 有限公 司	12,056,338. 16	0.75	1,568,982,00 0.00	7.69	-	-
招商证 券股份 有限公 司	212,613,101 .47	13.18	1,909,277,00 0.00	9.35	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	98,814,724. 85	6.13	2,592,887,00 0.00	12.70	-	-
民生证 券股份 有限公 司	164,399,734 .16	10.19	4,056,378,00 0.00	19.87	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	124,187,637 .17	7.70	2,691,201,00 0.00	13.19	-	-
开源证 券股份 有限公 司	155,513,458 .94	9.64	1,310,880,00 0.00	6.42	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	163,845,049 .67	10.16	268,746,000. 00	1.32	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	204,055,546 .39	12.65	1,359,383,00 0.00	6.66	-	-
海通证 券股份 有限公 司	58,948,121. 51	3.66	201,708,000. 00	0.99	-	-
国信证 券股份 有限公 司	38,249,892. 95	2.37	24,094,000.0 0	0.12	-	-

司						
天风证 券股份 有限公 司	89,235,705. 11	5.53	359,000,000. 00	1.76	-	-
广发证 券股份 有限公 司	132,186,940 .38	8.20	733,700,000. 00	3.59	-	-
长江证 券股份 有限公 司	21,067,432. 57	1.31	29,807,000.0 0	0.15	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	37,379,773. 93	2.32	1,051,000,00 0.00	5.15	-	-
华源证 券股份 有限公 司	13,279,759. 84	0.82	586,000,000. 00	2.87	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
高盛高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
中国银河证券股份有限公司	-	-	178,000,000.00	0.87	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实多元收益债券型证券投资基金 2024 年第一次收益分配公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 16 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会《关于核准嘉实多元收益债券型证券投资基金募集的批复》；
- (2) 《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实多元收益债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实多元收益债券型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实多元收益债券型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

11.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话 400-600-8800,
或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日